SIGMA FICFIM

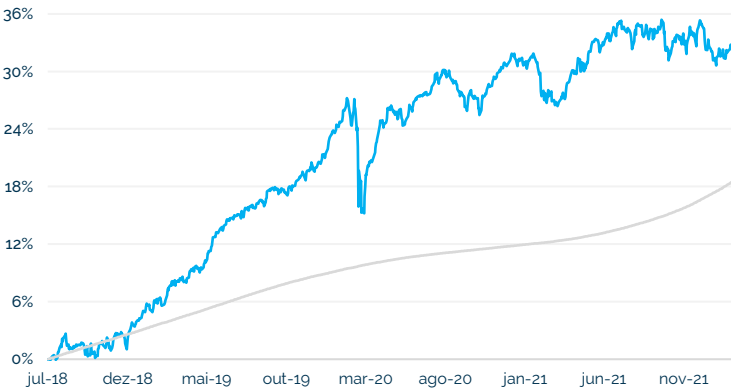
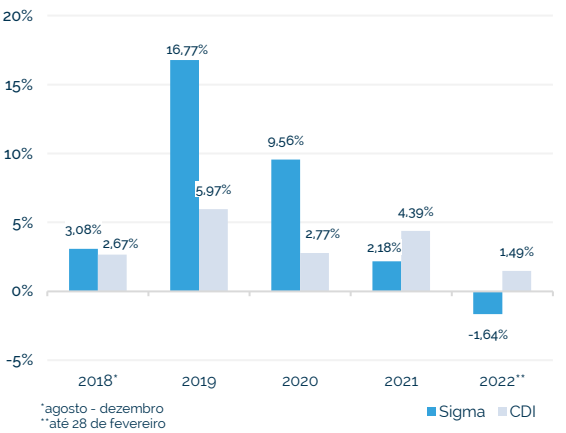
Fevereiro de 2022

OBJETIVO E ESTRATÉGIA

O fundo funciona como um imã de resultados: captura o prêmio de risco de ativos de bolsa, juros, câmbio e commodities no mundo inteiro, utilizando metodologia proprietária de otimização. Estratégia altamente diversificada e com posições meticulosamente balanceadas, compondo uma carteira que busca retorno independentemente do cenário.

DESEMPENHO & PATRIMÔNIO

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUMULADO
2022	FUNDO	-2,33%	0,70%											-1,64%	32,54%
	%CDI	-	94%											-	176%
2021	FUNDO	-1,20%	-2,20%	-0,47%	2,31%	1,79%	1,13%	0,65%	0,28%	-0,91%	-1,59%	0.67%	1,83%	2,18%	34,75%
	%CDI	-	-	-	1110%	668%	369%	183%	66%	-	-	114%	239%	50%	208%
2020	FUNDO	3,32%	0,00%	-3,39%	3,62%	1,18%	0,96%	0,97%	0,95%	-1,72%	-1,54%	2,99%	2,06%	9,56%	31,87%
	%CDI	882%	-	-	1.271%	496%	444%	501%	593%	-	-	2002%	1254%	345%	270%
2019	FUNDO	2,65%	-0,14%	2,24%	1,35%	1,62%	2,38%	0,65%	1,39%	1,38%	0,09%	0,92%	1,09%	16,77%	20,37%
	%CDI	488%	-	478%	261%	299%	509%	115%	276%	297%	20%	243%	290%	281%	232%
2018	FUNDO								1,30%	0,34%	-0,59%	1,24%	0,69%	3,00%	3,00%
	%CDI								229%	72%	-	251%	140%	116%	116%

RETORNO ACUMULADO

INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

Investimento inicial mínimo: R$ 25.000,00 ou R$ 500,00 via conta e ordem
Movimentação mínima: R$ 10.000,00 ou R$ 100,00 via conta e ordem
Saldo mínimo de permanência: R$ 20.000,00 ou R$ 100,00 via conta e ordem
Aplicação/Resgate: Até às 14:00h
Cotização/Pagamento: D+10/D+3
Taxa de administração: 1,45% a.a.
Taxa de performance: 20% sobre o que exceder 100% do CDI

Gestor: Giant Steps Capital Ltda.
Administrador: BNY Mellon
Auditor: KPMG
Categoria/Código ANBIMA: Multimercado Estratégia Livre/481645
CNPJ:29.826.089/0001-21

Volatilidade objetivo: 7% a.a.
Retorno objetivo: CDI + 5% a.a.

Morningstar Rating: ★★★★ (Allocation, up to 20% Equity 3 Anos)*

*Data de avaliação: 31/01/2022

Patrimônio Líquido	R$	397.066.286,86
Patrimônio Líquido da Estratégia	R$	1.037.252.324,96
Valor da Cota		1,3253625

	FUNDO	CDI	FUNDO % CDI
12 meses	4,01%	5,65%	71%
24 meses	6,57%	8,15%	81%
Desde o início	32,54%	18,46%	176%

Av. Brigadeiro Faria Lima, 4300 (15º andar) – São Paulo, SP. CEP 04538-132. Tel: +55 (11) 2533 – 2820 www.gscap.com.br